

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
HALAMAN MOTTO	v
PRAKATA	vi
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR LAMBANG	xi
INTISARI	xiii
ABSTRACT	xiv
I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Tujuan Penelitian	3
1.4 Tinjauan Pustaka	3
1.5 Metode Penelitian	4
1.6 Sistematika Penulisan	5
II DASAR TEORI	6
2.1 Probabilitas	6
2.2 Fungsi Survival	7
2.3 Tabel Mortalita	9
2.4 Tingkat Kematian Terpusat <i>Central Death of Rate</i>	12
2.5 Teori Bunga	13
2.5.1 Jenis-jenis bunga	14
2.5.2 Tingkat Bunga Nominal	15
2.6 Fungsi Anuitas	16
2.7 Model ARIMA	21
2.7.1 Model Moving Average	21
2.7.2 Model Autoregresif	22
2.7.3 Model Campuran Autoregresif - Moving Average	22
2.7.4 Proses Nonstasioner Homogen: Model ARIMA	23
2.8 Dekomposisi Nilai Singular	24

2.9	Model Mortalita Lee-Carter	28
2.10	Program Dana Pensiun	29
2.11	Perhitungan Dana Pensiun	30
III PENGELOLAAN DANA PENSIUN MENGGUNAKAN METODE GROUP SELF ANNUITIZATION (GSA) DAN METODE IURAN PASTI		32
3.1	Metode <i>Group Self Annuitization (GSA)</i>	32
3.2	Jenis Kontribusi dan Pembayaran Anuitas	36
3.3	Analisis Kohor	38
3.4	Model Lee-Carter dengan SVD	43
3.4.1	Estimasi Parameter c_x	44
3.4.2	Estimasi Parameter b_x dan k_t	45
3.4.3	Peramalan ARIMA	46
3.5	Hubungan antara ${}_t m_x$ dan ${}_t q_x$	48
3.6	Metode Iuran Pasti	48
IV STUDI KASUS		55
4.1	Deskripsi Data	55
4.2	Hasil Estimasi Parameter Model Lee-Carter	58
4.3	Tahap Peramalan Indeks Kematian	60
4.4	Pembentukan Tabel Mortalita	64
4.5	Interpolasi Data Tahunan ke Bulanan	66
4.6	Perhitungan Manfaat Pensiun	68
V KESIMPULAN		73
DAFTAR PUSTAKA		74
A SKRIP PROGRAM R		76
B TABEL MORTALITAS NEGARA TAIWAN		79
C UJI DIAGNOSTIK MODEL ARIMA		93
D HASIL PERHITUNGAN MANFAAT		97
4.1	Penurunan Rumus GSA	98